

Державний вищий навчальний заклад
«Донецький національний технічний університет»
Кафедра управління і фінансово-економічної безпеки



«ЗАТВЕРДЖУЮ»

Проректор з наукової роботи

Сергій ПОДКОПАЄВ

08 » 09 2022 р.

РОБОЧА ПРОГРАМА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

ДВП5 Ризик-орієнтоване управління

(шифр і назва навчальної дисципліни)

Рівень освіти: третій (освітньо-науковий)

Спеціальність: 073 Менеджмент

Освітня програма: Менеджмент

Мова навчання: українська

Луцьк – 2022

Робоча програма навчальної дисципліни «Ризик-орієнтоване управління» для аспірантів спеціальності 073 Менеджмент.

31. 08. 2022 р. – 10 с.

Розробники: Ляшок Я.О., професор, д-р економ. наук, ректор ДВНЗ «ДонНТУ»;

Попова О.Ю., професор, д-р економ. наук, завідувач кафедри управління і фінансово-економічної безпеки;

Ляшок Н.Ю., доцент, к-т економ. наук, доцент кафедри управління і фінансово-економічної безпеки

Робоча програма затверджена на засіданні кафедри управління і фінансово-економічної безпеки

Протокол № 1 від 31.08.2022 р.

31.08.2022 р.

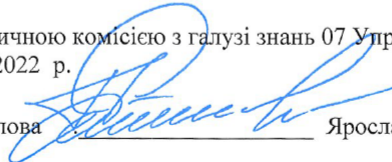
Зав. кафедри



Ольга ПОПОВА

Схвалено науково-методичною комісією з галузі знань 07 Управління та адміністрування № 1 від “ 08 ” вересня 2022 р.

“ 08 ” вересня 2022 р. Голова



Ярослав ЛЯШОК

Загальна інформація

Форма навчання	Денна	Заочна
Статус	Вільного вибору	Вільного вибору
Обсяг в кредитах ЄКТС	4	4
Обсяг в годинах за навчальним планом, разом: в тому числі:	120	120
лекцій:	16	6
практичні заняття:	16	2
лабораторні заняття:	---	---
семінари:	---	---
самостійна робота:	88	112
Індивідуальна робота	---	---
Форма підсумкового контролю	Залік	Залік
Дисципліну викладають	Викладач – Попова О.Ю., https://donntu.edu.ua/egf/ufeb , e-mail – olha.popova@donntu.edu.ua	

Передумови для вивчення дисципліни: менеджмент, економічна теорія, стратегічний менеджмент, економічна теорія, вища математика, теорія ймовірностей та математична статистика, управління ризиками.

2. Мета вивчення навчальної дисципліни

Мета навчальної дисципліни – формування у здобувачів системи знань з методів ризик-орієнтованого управління, використання управлінського інструментарію виявлення, протидії та попередження ризиків, опанування уміннями визначати ефективність заходів з управління ризиками, оцінювати потенційні та фактичні збитки від реалізації ситуації ризику, а також формування вмінь проводити дослідження, пов'язані з удосконаленням фінансово-економічного механізму ризик-орієнтованого управління.

Завдання дисципліни полягає в опануванні теоретичними знаннями для розв'язання практичних завдань та змістовно інтерпретувати отримані результати; демонстрації знань теорій, методів і функцій ризик-орієнтованого управління, навичок виявлення проблем та обґрунтування рішень з ризик-орієнтованого управління; застосовуванні методів оцінювання, аналізу та опору ризикам; демонстрації навичок аналізу рішень з впровадження стандартів ризик-орієнтованого управління, використання професійних програмних продуктів та здійснення відповідних управлінських заходів щодо підвищення ефективності ризик-орієнтованого управління.

Загальні компетентності:

- ЗК01. Здатність виявляти, ставити та вирішувати проблеми
- ЗК02. Здатність до пошуку, оброблення та аналізу інформації з різних джерел
- ЗК03. Здатність працювати в міжнародному контексті.
- ЗК04. Здатність розв'язувати комплексні проблеми у сфері менеджменту на основі системного наукового світогляду та загального культурного кругозору із дотриманням принципів професійної етики та академічної доброчесності.

Фахові компетентності:

ФК01. Здатність виконувати оригінальні дослідження, досягати наукових результатів, які створюють нові знання у менеджменті і дотичних до нього міждисциплінарних напрямках.

ФК02. Здатність усно і письмово презентувати та обговорювати результати наукових досліджень та/або інноваційних розробок українською та англійською мовами, опрацьовувати наукову літературу з управління та адміністрування та ефективно використовувати нову інформацію з різних джерел.

ФК03. Здатність здійснювати науково-педагогічну діяльність у сфері менеджменту в закладах вищої освіти.

ФК04. Здатність ініціювати, розробляти, реалізовувати та управляти науковими проектами у менеджменті і дотичних до нього міждисциплінарних напрямках та /або складати пропозиції щодо фінансування наукових досліджень, реєстрації прав інтелектуальної власності.

Програмні результати навчання:

ПРН02. Вільно презентувати та обговорювати з фахівцями і нефахівцями результати досліджень, наукові та прикладні проблеми менеджменту державною та англійською мовами, кваліфіковано відображати результати досліджень у наукових публікаціях у провідних міжнародних наукових виданнях.

ПРН03. Розробляти та досліджувати концептуальні, математичні і комп'ютерні моделі процесів і систем, ефективно використовувати їх для отримання нових знань та/або створення інноваційних продуктів у галузі менеджменту та дотичних міждисциплінарних напрямках.

ПРН05. Глибоко розуміти загальні принципи та методи управлінських наук, а також методологію наукових досліджень, застосовувати їх у власних дослідженнях у сфері менеджменту та у викладацькій практиці.

ПРН06. Планувати і виконувати наукові і прикладні дослідження з менеджменту та дотичних міждисциплінарних напрямків з використанням сучасних інструментів, критично аналізувати результати власних досліджень і результати інших дослідників у контексті усього комплексу сучасних знань щодо досліджуваної проблеми; складати пропозиції щодо фінансування досліджень та/або проектів.

ПРН08. Розробляти і викладати спеціальні навчальні дисципліни з менеджменту у закладах освіти.

3. Очікувані результати навчання

Після засвоєння дисципліни «Ризико-орієнтоване управління» здобувачі повинні:

- знати базові визначення ризик-орієнтованого управління, ризик-менеджменту як економічних категорій;
- бути обізнаними в змісті та специфіці форм і процедур оцінювання та аналізу рішень з ризик-орієнтованого управління;
- визначати та позиціонувати ефективність ризик-орієнтованого управління в системі стратегічного менеджменту;
- вільно володіти термінологічним апаратом;
- розуміти значення й особливості найбільш поширених моделей управління реагування на ризик та міжнародних стандартів ризик-орієнтованого управління;
- уміти самостійно готувати презентацію, есе, що містить висвітлення проблеми, мети, методів та засобів дослідження, порядок обробки даних, висновки щодо вирішення поставленого завдання; вести діалог та наукову дискусію, захищати авторську позицію у сфері управління природними ресурсами та у викладацькій практиці;
- володіти навичками ознайомлювального, вибіркового й вивчаючого читання на матеріалах оригінальних наукових текстів з питань ризик-орієнтованого управління, ризик-менеджменту;
- володіти навичками написання есе, доповідей, заявок (зокрема для участі на конференціях);
- володіти навичками перекладу як з англійської мови на рідну, так і з рідної на англійську в межах фахової тематики;
- застосовувати професійну термінологію, понятійний апарат та лексику зі спеціальності 073 Менеджмент.

4. Засоби діагностики результатів навчання

Засоби оцінювання та методи перевірки результатів навчання:

- презентація (поточний контроль);
- експрес тести за темами для самостійного вивчення (поточний контроль);
- експрес тести за темами лекційних занять (поточний контроль);
- проблемно-орієнтована дискусія за темами лекційних занять та темами самостійної роботи (поточний контроль);
- поточні контрольні роботи за темами лекційних занять та темами самостійної роботи (поточний контроль)
- залік (підсумковий контроль).

5. Критерії оцінювання результатів навчання

Поточний контроль відбувається під час практичних занять.

Підсумковий (семестровий) контроль здійснюється у формі заліку в обсязі навчального матеріалу, визначеного навчальною програмою дисципліни «Ризик-орієнтоване управління», і в терміни, встановлені навчальним планом та графіком навчального процесу.

Максимальний бал, що може отримати аспірант за результатами поточного контролю дорівнює 40 балів. За наявності помилок або при несвоєчасному виконанні оцінка знижується до 60% від максимальної. завдання. Під час семестрового контролю враховуються результати усіх видів роботи відповідно до розподілу балів, які отримують аспіранти:

Поточний контроль для денної форми навчання								Максимальний бал(залік)
Пр1	Пр2	Пр3	Пр4	Пр5	Пр6	Пр7	Пр8	
12	13	12	13	12	13	12	13	100
7	8	7	8	7	8	7	8	60

Примітки: 1) Пр1, Пр2 і т.д. практичні заняття;

2) У чисельнику максимальний бал – при своєчасному та правильному виконанні, у знаменнику – мінімальний (при правильному, але несвоєчасному виконанні)

Поточний контроль, заочна форма навчання		Максимальний бал(залік)
ПР1	ПР2	
50	50	100
30	30	60

Критерії оцінювання складових поточного контролю (залежно від поставлених задач та вибраної складової контролю перед аспірантом на поточному практичному занятті):

Презентація – макс. 5 балів:

- структура, логіка побудови:
 - * наявні всі елементи презентації (вступ, основна частина, заключна частина), вірно визначені об'єкт, предмет, мета, задачі, усі частини презентації містять необхідні елементи – макс. 3 б.,
- термінологічний апарат презентації:
 - * вживання термінів і понять є коректним та адекватним – макс. 2 б.

Експрес тести – макс. 5 балів:

- усе відповіді є правильними – макс. 5 б.

Проблемно-орієнтована дискусія – правильна структура, переконливість, лаконічність, коректність вживання фахової термінології, відповідність вимогам, наявність усіх елементів, етичність – від 0 до 5 балів,

Поточні контрольні роботи – правильність отриманих результатів, наявність ґрунтовних висновків, викладення методики вирішення поставлених задач – від 0 до 5 балів.

Підсумкове оцінювання здійснюється за 100-бальною шкалою та національною шкалою для заліку «зараховано», «незараховано». При оформленні документів за

екзаменаційну сесію використовується таблиця відповідності оцінювання знань за різними шкалами:

Шкала оцінювання

Сума балів за всі види навчальної діяльності	Оцінка за національною шкалою для заліку
90-100	зараховано
74-89	
60-73	
0-59	не зараховано

6. Програма навчальної дисципліни

6.1. Основні теми дисципліни

Тема 1. Предмет і основні задачі дисципліни «Ризик-орієнтоване управління».

1. Ризик-орієнтоване управління.
2. Управління цілями та процесами підприємства з урахуванням чинників невизначеності.
3. Поняття «попереджувальні дії».
4. Типи ризик-орієнтованого управління
5. Етапи організації ризик-орієнтованого управління
6. Документація підприємства з ризик-менеджменту
7. Перешкоди поширення ризик-орієнтованого управління

Тема 2. Стратегічний ризик-менеджмент.

1. Ухилення від ризиків.
2. Прийняття ризиків.
3. Розподіл та аутсорсинг ризику.
4. Попередження ризику.
5. Зниження ступеня ризику

Тема 3. Методи реагування на ризик

1. Самострахування
2. Кептивне страхування
3. Типи договорів, що використовуються для розподілу ризику
4. Договори гарантії та поруки
5. Договір факторингу

Тема 4. Міжнародні стандарти з ризик-орієнтованого управління.

1. Стандарт з управління ризиками Федерації європейських ризик-менеджерів (FERMA).
2. Стандарт «Управління ризиками організацій. Інтегрована модель» (COSO).
3. Стандарт ISO 31000:2018.
4. Basel.
5. Solvency

Тема 5. Стандарти з ризик-орієнтованого управління, імплементовані в Україні.

1. ДСТУ ISO Guide 73:2013 Управління ризиком..
2. ДСТУ ІЕС/ISO 31010:2013 Керування ризиком. Методи загального оцінювання ризику.
3. ДСТУ ISO 31000:2018 Менеджмент ризиків. Принципи та настанови.
4. ДСТУ ISO/TR 31004:2018 Менеджмент ризиків. Настанова з впровадження ISO 31000

Тема 6. Ідентифікація ризиків.

1. Алгоритмізація ризик-орієнтованого управління.
2. Імовірнісний підхід до оцінки ризиків (помилки I і II роду при контролі параметрів процесу ризик-орієнтованого управління).
3. Аналіз та оцінка ризиків.
4. Вибір та реалізація стратегій ризик-орієнтованого управління.

Тема 7. Оцінювання ризику:

1. Креативні методи (мозковий штурм; метод Делфи; структуроване або напівструктуроване інтерв'ю).
2. Аналіз сценаріїв (аналіз причин і наслідків; аналіз дерева відмов; аналіз дерева події; аналіз сценаріїв; дерево рішень; аналіз рівня захисту; аналіз ризику для навколишнього середовища та інші.).
3. Методи аналізу індикаторів (чек-листи; CIRS; CBRM).
4. Методи функціонального аналізу (FMEA; аналіз небезпек; HAZOR; HACCP; аналіз людської надійності).
5. Статистичні методи аналізу (FN крив; аналіз Маркова; метод МонтеКарло; статистика Бейса і мережі Бейса).

Тема 8. Програмні засоби та методика ризик-орієнтованого управління.

1. CORAS.
2. CRAMM.
3. Risk Watch
4. Oracle Crystal Ball
5. OCTAVE

6.2. Теми практичних занять

№ з/п	Назва теми	Кількість годин	
		денна форма	заочна форма
1	Тема 1. Предмет і основні задачі дисципліни «Ризик-орієнтоване управління». Економічні методи ризик-орієнтованого управління. Основні принципи ризик-орієнтованого управління	2	1
2	Тема 2. Стратегічний ризик-менеджмент. Концепція стратегічного ризик-орієнтованого управління.	2	
3	Тема 3. Методи реагування на ризик. Інформаційне забезпечення ризик-орієнтованого управління	2	
4	Тема 4. Міжнародні стандарти з ризик-орієнтованого управління. Класифікація міжнародних стандартів з ризик-орієнтованого управління.	2	
5	Тема 5. Стандарти з ризик-орієнтованого управління, імplementовані в Україні. Класифікація стандартів з ризик-орієнтованого управління, імplementованих в Україні	2	
6	Тема 6. Ідентифікація ризиків. Укрупнена оцінка джерел невизначеності та ризику. Методи якісних та кількісних оцінок.	2	

7	Тема 7. Оцінювання ризику.	2	1
	Методи оцінки ризиків в різних сферах управлінської діяльності.	2	
8	Тема 8. Програмні засоби та методики ризик-орієнтованого управління. Виявлення ризику, ведення статистичної та реєстраційної обробки інцидентів, розробка та реалізація заходів з підвищення безпеки підприємства, здійснення страхової діяльності, укладання угод зі страхування та перестрахування		
	Усього годин	16	2

6.3 Самостійна робота

№ з/п	Назва теми	Кількість годин	
		денна форма	заочна форма
1	Тема 1. Предмет і основні задачі дисципліни «Ризик-орієнтоване управління». Фактори ризик-орієнтованого управління. Невизначеність та ризик Причини невизначеності	11	14
2	Тема 2. Стратегічний ризик-менеджмент. Ознаки ризикової ситуації. Зв'язок ризику і шансу. Стратегії ризик-орієнтованого управління	11	14
3	Тема 3. Методи реагування на ризик. Життєвий цикл ризикової ситуації. система евристичних правил ризик-орієнтованого управління	11	14
4	Тема 4. Міжнародні стандарти з ризик-орієнтованого управління. Стандарти Інституту Ризик-Менеджменту (IRM), Асоціації РизикМенеджменту й Страхування (AIRMIC), Федерації Європейських Асоціацій РизикМенеджменту (FERMA), а також Національного Суспільного Форуму Ризик-Менеджменту.	11	14
5	Тема 5. Стандарти з ризик-орієнтованого управління, імплементовані в Україні. Основні положення ISO 31000:2018. ISO 31010:2019 Risk management – Risk assessment techniques	11	14
6	Тема 6. Ідентифікація ризиків. Основні глобальні загрози (ризикові ситуації) в XIX століття. Теорія «Чорний лебідь».	11	14
7	Тема 7. Оцінювання ризику. Концепція прийнятного ризику, ризик-апетиту та толерантності до ризику. Принцип ефективності управління ризиками	11	14
8	Тема 8. Програмні засоби та методики ризик-орієнтованого управління. Звітність за ризиками. Структура концепції ризик-менеджменту в COSO ERM.	11	14
	Усього годин	88	112

6.4 Індивідуальні та/або групові завдання

Виконання навчально-дослідного завдання не передбачено.

7. Література

7.1. Основна

1. ISO 31000. Менеджмент ризиків. URL: <https://www.iso.org/ru/iso-31000-risk-management.html>
2. Ризик-орієнтоване планування діяльності з внутрішнього аудиту Методичний посібник. URL: https://mof.gov.ua/storage/files/5__%D0%9C%D0%B5%D1%82%D0%BE%D0%B4%D0%B8%D1%87%D0%BD%D0%B8%D0%B9_%D0%BF%D0%BE%D1%81%D1%96%D0%B1%D0%BD%D0%B8%D0%BA_%D0%A0%D0%B8%D0%B7%D0%B8%D0%BA-%D0%BE%D1%80%D1%96%D1%94%D0%BD%D1%82%D0%BE%D0%B2%D0%B0%D0%BD%D0%B5_%D0%BF%D0%BB%D0%B0%D0%BD%D1%83%D0%B2%D0%B0%D0%BD%D0%BD%D1%8F_%D0%B4%D1%96%D1%8F%D0%BB%D1%8C%D0%BD%D0%BE%D1%81%D1%82%D1%96_%D0%B7_%D0%B2%D0%BD%D1%83%D1%82%D1%80%D1%96%D1%88%D0%BD%D1%8C%D0%BE%D0%B3%D0%BE_%D0%B0%D1%83%D0%B4%D0%B8%D1%82%D1%83.pdf
3. Управління ризиками: Навчальний наочний посібник [Електронний ресурс]: навч. посіб. для студ. спеціальності 073 «Менеджмент» / М.О. Кравченко, К.О. Бояринова, К.О. Копішинська; КПІ ім. Ігоря Сікорського. – Електронні текстові дані (1 файл: 18 Мбайт). – Київ : КПІ ім. Ігоря Сікорського, 2021. – 432с.
4. Савельєва, Т. В., Панаско, О. М., & Пригодюк, О. М. (2018). Аналіз методів і засобів для реалізації ризик-орієнтованого підходу в контексті забезпечення інформаційної безпеки підприємства. *Вісник Черкаського державного технологічного університету*, 1(1), 81–89. <https://doi.org/10.24025/2306-4412.1.2018.153279>

7.2. Додаткова

5. Управління ризиками: Навчальний наочний посібник [Електронний ресурс]: навч. посіб. для студ. спеціальності 073 «Менеджмент» / М.О. Кравченко, К.О. Бояринова, К.О. Копішинська; КПІ ім. Ігоря Сікорського. Електронні текстові дані (1 файл: 18 Мбайт). Київ : КПІ ім. Ігоря Сікорського, 2021. 432с. file:///D:/Downloads/Upravlinnia-ryzykamy_NavchNaochPosib.pdf
6. Герасименко О.М. Ризик-орієнтоване управління в системі економічної безпеки підприємства – Рукопис. Дисертація на здобуття наукового ступеня доктора економічних наук за спеціальністю 21.04.02 – економічна безпека суб'єктів господарської діяльності - ВНЗ «Університет економіки та права «КРОК», Київ, 2021. URL: https://library.krok.edu.ua/media/library/category/disertatsiji-avtoreferati-vidguki/gerasimenko_2021-disertatsija.pdf
7. Сосновська О. О., Деденко Л. В. Ризик-менеджмент як інструмент забезпечення стійкого функціонування підприємства в умовах невизначеності. *Європейський науковий журнал Економічних та Фінансових інновацій*. 2019. № 1(3). С. 70–79. DOI: <http://doi.org/10.32750/2019-0106>
8. Луганова І.А. Сутність та принципи концепції ризик-менеджменту. *Актуальні проблеми державного управління*. Вип. 1 (53)/2018. URL: <http://www.kbuara.kharkov.ua/e-book/apdu/2018-1/doc/2/04.pdf>

7.3. Методична

1. Методичні рекомендації до практичних занять з дисципліни «Ризико-орієнтоване управління» / О.Ю. Попова, Я.О. Ляшок, І.Б. Швець Луцьк: ДонНТУ, 2023. 30 с. (заплановано).
2. Методичні рекомендації до самостійної роботи з дисципліни «Ризико-орієнтоване управління» / О.Ю. Попова, Я.О. Ляшок, І.Б. Швець Луцьк: ДонНТУ, 2023. 30 с. (заплановано).

8. Інформаційні ресурси

1. Офіційний сайт Міжнародної організації зі стандартизації (International Organization for Standardization, ISO). URL: <https://www.iso.org/committee/629121/x/catalogue/>
2. ДСТУ ISO 31000:2018 Менеджмент ризиків. Принципи та настанови (ISO 31000:2018 Risk Management – Principles and guidelines on implementation, IDT). [Чинний від 2019-01-01]. URL: <https://www.iso.org/obp/ui/#iso:std:iso:31000:ed-2:v1:en>
3. ДСТУ ISO/TR 31004:2013 Управління ризиками – Керівництво з впровадження ISO 31000 (Risk management – Guidance for the implementation of ISO 31000, IDT). [Чинний від 2019-01-01]. URL: <https://www.iso.org/standard/56610.html?browse=tc>
4. Овандер Н.Л. Огляд міжнародних та українських стандартів з управління ризиками з погляду сучасних викликів та загроз. *Економіка та суспільство*. 2021. Випуск 27. DOI: <https://doi.org/10.32782/2524-0072/2021-27-26>
5. Національна бібліотека України ім. В.І. Вернадського: офіційний веб-портал. URL: <http://nbu>
6. Federation of European Risk Management Associations. URL: <https://www.ferma.eu/>